

ROC Reversal EA - Manuel d'utilisation

Table des matières

1. [Introduction](#)
2. [Stratégie](#)
3. [Installation](#)
4. [Paramètres](#)
5. [Utilisation](#)
6. [Gestion des risques](#)
7. [Optimisation](#)
8. [Avertissements](#)

Introduction

ROC Reversal EA est un Expert Advisor automatisé pour MetaTrader 5 qui utilise l'indicateur Rate of Change (ROC) pour identifier les retournements de momentum et générer des signaux de trading.

Caractéristiques principales

- Stratégie basée sur les retournements d'élan (momentum reversal)
- Filtre de tendance avec EMA 100
- Gestion automatique des stop-loss et take-profit
- Trailing stop après 1R de profit
- Compatible avec tous les timeframes (optimisé pour H1)
- Magic Number : **700041**

Stratégie

Principe de base

La stratégie ROC Reversal exploite les mouvements extrêmes du Rate of Change pour capturer les retournements de prix après des mouvements de momentum excessifs.

Rate of Change (ROC)

Le ROC mesure le pourcentage de variation du prix sur une période donnée :

$$ROC = ((\text{Prix actuel} - \text{Prix il y a N périodes}) / \text{Prix il y a N périodes}) \times 100$$

Conditions d'entrée

Position longue (ACHAT)

1. **Condition préalable** : ROC(12) tombe en dessous de -2% (momentum négatif extrême)
2. **Signal d'entrée** : ROC commence à remonter (ROC[0] > ROC[1]) et devient positif
3. **Filtre de tendance** (optionnel) : Prix au-dessus de l'EMA 100

Position courte (VENTE)

1. **Condition préalable** : ROC(12) monte au-dessus de +2% (momentum positif extrême)
2. **Signal d'entrée** : ROC commence à baisser (ROC[0] < ROC[1]) et devient négatif
3. **Filtre de tendance** (optionnel) : Prix en dessous de l'EMA 100

Gestion des positions

Stop Loss

- **Distance** : $2,5 \times ATR(14)$
- **Placement** : Automatique à l'ouverture de la position

Take Profit

- **Condition** : ROC retourne vers zéro (entre -0,5% et +0,5%)
- **Logique** : Le momentum se normalise, signal de sortie

Trailing Stop

- **Activation** : Après 1R de profit (1 fois la distance du stop loss initial)
- **Niveau** : Prix d'entrée + $0,5 \times ATR$ pour les longs
- **Niveau** : Prix d'entrée - $0,5 \times ATR$ pour les courts

Installation

Prérequis

- MetaTrader 5 (version récente recommandée)
- Compte de trading avec accès aux données historiques H1
- Connexion internet stable

Étapes d'installation

1. **Téléchargement** : Copiez le fichier R0CReversible.mq5 dans le dossier :

2. Compilation :

- Ouvrez MetaEditor (F4 dans MT5)
- Ouvrez le fichier ROCReversalEA.mq5
- Compilez avec F7
- Vérifiez l'absence d'erreurs

3. Activation :

- Redémarrez MetaTrader 5
- Glissez-déposez l'EA sur le graphique souhaité
- Configurez les paramètres
- Activez le trading automatique

Paramètres

Paramètres de stratégie

Paramètre	Valeur par défaut	Description
ROC_Period	12	Période de calcul du Rate of Change
ROC_Threshold	2.0	Seuil d'extrême en pourcentage ($\pm 2\%$)
EMA_Period	100	Période de l'EMA pour le filtre de tendance
ATR_Period	14	Période de calcul de l'ATR
ATR_Multiplier	2.5	Multiplicateur ATR pour le stop loss
UseEMAFilter	true	Activer/désactiver le filtre EMA
UseTrailingStop	true	Activer/désactiver le trailing stop

Gestion des risques

Paramètre	Valeur par défaut	Description
LotSize	0.1	Taille de position fixe
MaxSpread	3.0	Spread maximum autorisé (points)
Slippage	3	Glissement maximum autorisé

Paramètres généraux

Paramètre	Valeur par défaut	Description
MagicNumber	700041	Numéro magique unique
EAComment	"ROC Reversal EA"	Commentaire des ordres

Utilisation

Configuration recommandée

- **Paire** : EURUSD (par défaut)
- **Timeframe** : H1 (optimisé)
- **Spread** : < 3 points
- **Période de test** : Minimum 3 mois de données historiques

Étapes de mise en œuvre

1. **Test en démo** :
 - Testez d'abord sur un compte de démonstration
 - Vérifiez les performances sur 1-3 mois
 - Analysez le drawdown maximum
2. **Optimisation** :
 - Utilisez le testeur de stratégies de MT5
 - Optimisez sur 1 an de données historiques
 - Validez sur une période différente
3. **Mise en production** :
 - Commencez avec une taille de position réduite
 - Surveillez quotidiennement les premiers trades
 - Ajustez les paramètres si nécessaire

Monitoring

- **Vérifiez quotidiennement** : Position ouverte, P&L
- **Hebdomadairement** : Performance globale, drawdown
- **Mensuellement** : Ratio de réussite, profit factor

Gestion des risques

Règles de base

1. **Ne jamais risquer plus de 2% du capital par trade**
2. **Diversifier les paires si possible**
3. **Arrêter l'EA en cas de news importantes**
4. **Surveiller le drawdown maximum**

Calcul de la taille de position

Taille lot = (Capital × Risque%) / (Distance SL × Valeur du point)

Exemple de calcul

- Capital : 10 000 €
- Risque : 1% = 100 €
- Distance SL : 50 points (2,5 × ATR = 2,5 × 20)
- Valeur du point EURUSD : 1 € (pour 0.01 lot)
- Taille recommandée : 100 € / (50 × 1 €) = 2 lots

Optimisation

Paramètres à tester

1. **ROC_Period** : 10, 12, 14, 16
2. **ROC_Threshold** : 1.5, 2.0, 2.5, 3.0
3. **ATR_Multiplier** : 2.0, 2.5, 3.0
4. **EMA_Period** : 50, 100, 200

Méthode d'optimisation

1. **Forward analysis** : Optimiser sur 70% des données, tester sur 30%
2. **Walk-forward** : Optimisation glissante sur 6 mois, test sur 1 mois
3. **Métriques importantes** :
 - Profit Factor > 1.3
 - Drawdown maximum < 15%
 - Ratio de Sharpe > 1.0

Périodes de marché

- **Trending markets** : Réduire ROC_Threshold, augmenter EMA_Period
- **Range markets** : Augmenter ROC_Threshold, réduire ATR_Multiplier
- **Volatile markets** : Augmenter ATR_Multiplier, activer trailing stop

Avertissements

Risques généraux

⚠ Le trading automatisé comporte des risques élevés de perte

- Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs
- L'EA peut subir des pertes consécutives importantes
- Les conditions de marché peuvent changer et affecter la stratégie
- Toujours tester en démonstration avant utilisation réelle

Conditions de marché défavorables

- **News économiques** : Arrêter l'EA 30 min avant/après
- **Faible liquidité** : Éviter les sessions de fin de semaine
- **Spreads élevés** : L'EA s'arrête automatiquement si spread > MaxSpread
- **Forte volatilité** : Surveiller attentivement les positions

Limitations techniques

- Requiert une connexion internet stable
- Sensible aux requotes et slippage
- Performance dépendante de la qualité des données historiques
- Peut nécessiter des ajustements selon le courtier

Support et mises à jour

- Vérifiez régulièrement les mises à jour
 - Testez toujours les nouvelles versions en démonstration
 - Documentez vos paramètres optimisés
 - Conservez des sauvegardes de configuration
-

Informations légales

Avis de non-responsabilité : Ce logiciel est fourni “tel quel” sans garantie. L'utilisateur assume tous les risques liés au trading automatisé. Les auteurs ne peuvent être tenus responsables des pertes financières.

Version : 1.0

Date : Février 2024

Compatibilité : MetaTrader 5

Pour toute question technique, consultez la documentation MetaTrader 5 ou contactez votre courtier.